

Formular 1
Adecvarea capitalului la riscuri

ALACIACA01

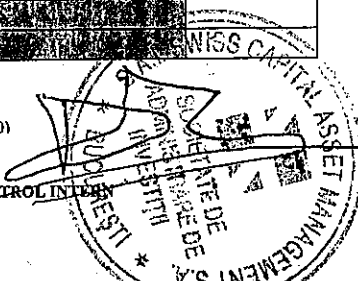
Indicativ	Nr. Crt	Eticheta	Valoare (LEI)
T	1	FONDURI PROPRII TOTALE	2,489,203.16
T	1.1	FONDURI PROPRII DE NIVEL 1	2,489,203.16
T	1.1.1	Capital eligibil	430,000.00
N	1.1.1.*	din care: instrumente non-inovative subiect al limitei	
N	1.1.1.**	din care: instrumente inovative subiect al limitei	
T	1.1.1.1	Capital social subscris și vărsat	430,000.00
T	1.1.1.2	(-) Acțiuni proprii	
T	1.1.1.3	Prime de capital	
C	1.1.1.4	Alte instrumente eligibile de capital	
T	1.1.2	Rezerve eligibile	2,059,203.16
T	1.1.2.1	Rezerve	2,059,203.16
T	1.1.2.1.01	Rezerve (inclusiv diferențe din evaluare)	2,059,203.16
C	1.1.2.1.02	Parte a rezervelor care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
C	1.1.2.2	Interes minoritar	0.00
C	1.1.2.2.01	Interes minoritar (inclusiv diferențe din evaluare)	
C	1.1.2.2.02	Parte a interesului minoritar care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
C	1.1.2.2.03	(-) Ajustări la interesul minoritar	
N	1.1.2.2*	din care: instrumente non-inovative supuse limitării	
N	1.1.2.2**	din care: instrumente inovative supuse limitării	
T	1.1.2.3	Rezultatul net al exercițiului financiar curent reprezentând profit	0.00
T	1.1.2.3.01	Profit auditat din anul curent	
C	1.1.2.3.02	Parte a profitului auditat din anul curent, care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.4a	Pierdere curentă	0.00
T	1.1.2.4a.01	Rezultatul neauditat (profit sau pierdere) din anul curent	
C	1.1.2.4a.02	Parte a rezultatului neauditat din anul curent, care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.4b	Rezultatul net al exercițiului financiar curent reprezentând pierdere	
T	1.1.2.4b.01	(-) Profit sau pierdere curentă	
C	1.1.2.4b.02	Parte a rezultatului negativ din anul curent care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.5	(-) Cașuguri nete din capitalizarea profiturilor viitoare din active ce fac obiectul operațiunilor de capitalizare	0.00
C	1.1.2.6	Diferențe din evaluare eligibile pentru includerea în fondurile proprii de nivel 1	
C	1.1.2.6.01	Diferențe din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.02	Ajustări la diferențele din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.03	Diferențe din evaluarea creditelor și creanțelor înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.04	Ajustări la diferențele din evaluarea creditelor și creanțelor înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.05	Diferențe din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.06	Ajustări la diferențele din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.07	Diferențe din evaluarea datoriilor financiare la valoarea justă determinate de modificarea propriei calități de credit	
C	1.1.2.6.08	Ajustări la diferențele din evaluarea datoriilor financiare la valoarea justă determinate de modificarea propriei calități de credit	
C	1.1.2.6.09	Diferențe din evaluare provenite din operațiuni de acoperire a fluxurilor de trezorerie privind activele care nu sunt înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.10	Ajustări la diferențele din evaluare determinate de operațiuni de acoperire a fluxurilor de trezorerie	
C	1.1.2.6.11	Diferențe din evaluarea investițiilor imobiliare	
C	1.1.2.6.12	Ajustări la diferențele din evaluarea investițiilor imobiliare	
C	1.1.2.6.13	Diferențe din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente)	
C	1.1.2.6.14	Ajustări la diferențele din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente)	
C	1.1.2.6.15	Alte diferențe din evaluare care afectează rezervele eligibile	
C	1.1.2.6.16	Ajustări la alte diferențe din evaluare care afectează rezervele eligibile	
N	1.1.3	Fonduri pentru riscurile bancare generale	0.00
C	1.1.4	Alte fonduri proprii de nivel 1 specifice României	
N	1.1.4.1	Instrumente non inovative supuse limitării	
N	1.1.4.2	Instrumente inovative supuse limitării	
N	1.1.4.3	Filtru prudentțial pozitiv adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
C	1.1.4.4	Alte filtre prudentțiale	
T	1.1.5	(-) Alte deduceri din fondurile proprii de nivel 1	0.00
T	1.1.5.1	(-) Imobilizări necorporale	
N	1.1.5.2	Sume ce depășesc limite stabilite pentru instrumente non inovative	
N	1.1.5.3	Sume ce depășesc limite stabilite pentru instrumente inovative	
T	1.1.5.4	(-) Alte deduceri specifice României din fondurile proprii de nivel 1	0.00
N	1.1.5.4.1	(-) Filtru prudentțial negativ adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
T	1.1.5.4.2	(-) Alte filtre prudentțiale	
T	1.2	FONDURI PROPRII DE NIVEL 2	0.00
T	1.2.1	Fonduri proprii de nivel 2 de bază	0.00
N	1.2.1.1	Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii de nivel 1, inclusă în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
C	1.2.1.2	Ajustări la diferențele din evaluare deduse din fondurile proprii de nivel 1 și incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	0.00
C	1.2.1.2.01	Ajustări la diferențele din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare, inclusă în fondurile proprii de nivel 2 de bază	

C	1.2.1.2.02	Ajustări la diferențele din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
C	1.2.1.2.03	Ajustări la diferențele din evaluarea investițiilor imobiliare incluse în fondurile proprii de nivel 2	
C	1.2.1.2.04	Ajustări la diferențele din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente) incluse în fondurile proprii de nivel 2	
C	1.2.1.2.05	Alte ajustări la diferențele din evaluare care afectează rezervele eligibile, incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
T	1.2.1.3	Rezerve din reevaluare	0.00
N	1.2.1.4	Ajustări de valoare a pozițiilor de risc de credit în abordarea standard	
T	1.2.1.5	Alte elemente, din care:	
T	1.2.1.6	Titluri pe durată nedeterminată și alte instrumente:	
T	1.2.1.7	Excedent de provizioane în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.2.1.8	Fonduri proprii de nivel 2 de bază specifice României	
T	1.2.2	Fonduri proprii de nivel 2 suplimentar	0.00
N	1.2.2.1	Angajamente ale membrilor instituțiilor de credit înființate ca și societăți cooperatiste	
T	1.2.2.2	Acțiuni preferențiale cumulative pe durată determinată	
T	1.2.2.3	Împrumuturi subordonate	
T	1.2.2.4	Fonduri proprii de nivel 2 suplimentar, specifice României	
T	1.2.2.5	(-) Suma ce excede limitele prevăzute pentru nivelul fondurilor proprii de nivel 2 suplimentar	
T	1.2.3	(-) Deduceri din fondurile proprii de nivel 2	0.00
T	1.2.3.1	(-) Suma ce excede limitele prevăzute pentru nivelul fondurilor proprii de nivel 2	
T	1.2.3.2	(-) Alte elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 2 suplimentar, specifice României	
T	1.3	(-) ELEMENTE DEDUCTIBILE DIN FONDURILE PROPRII DE NIVEL 1 ȘI 2	0.00
T	1.3 T1*	Din care : (-) Din fondurile proprii de nivel 1	
T	1.3 T2*	(-) Din fondurile proprii de nivel 2	
T	1.3.1	(-) Valoarea acțiunilor și a altor titluri de capital deținute în alte instituții de credit sau financiare, care depășesc 10% din capitalul social al acestora	0.00
T	1.3.2	(-) Creanțe subordonate și alte instrumente înregistrate în instituții de credit și financiare în care sunt înregistrate dețineri de acțiuni și alte titluri de capital ce depășesc 10% din capitalul social al acestora	
T	1.3.3	(-) Suma ce excede limita stabilită pentru deținerea de acțiuni și alte titluri de capital, creanțe subordonate și alte elemente înregistrate în instituții de credit și financiare în care sunt înregistrate	
T	1.3.4	(-) Participații deținute în societăți de asigurare, societăți de reasigurare, societăți holding de asigurare	
T	1.3.5	(-) Alte instrumente deținute în societăți de asigurare, societăți de reasigurare, societăți holding de asigurare în care este menținută o participație	
T	1.3.6	(-) Elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 1 și 2, specifice României	
C	1.3.EM	Element memorandum Fonduri proprii relevante pentru limitele aplicate expunerilor mari atunci când nu se utilizează fonduri proprii de nivel 3 pentru acoperirea riscurilor de piață și pentru	
T	1.3.7	(-) Anumite expuneri din securitizare neincluse în activele ponderate la risc	
T	1.3.8	(-) Deficit de provizioane și valoarea pierderilor așteptate aferente creanțelor provenind din titluri de capital în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.3.9	(-) Participații calificate în instituții din afara sectorului financiar	
T	1.3.10	(-) Tranzacții incomplete aflate în perioada cuprinsă în intervalul de la 5 zile lucrătoare după al doilea cambant al tranzacției (convențând plată/livrare contractului) și până la stingerea	
T	1.3.11	(-) Alte elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 1 și 2, specifice României	
T	1.4	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 1	2,489,203.16
T	1.5	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 2	0.00
T	1.6	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 2 SPECIFICE PENTRU ACOPERIREA RISCURILOR DE PIATĂ	0.00
T	1.6.1	Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii de nivel 2, transferată la total fonduri proprii de nivel 2 specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.6.2	Profituri nete aferente portofoliului de tranzacționare	0.00
T	1.6.3	Capital sub formă de împrumut subordonat pe termen scurt	
T	1.6.4	(-) Active nelichide	
T	1.6.5	(-) Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.6.EM	Element memorandum: Fonduri proprii totale relevante pentru limitele expunerilor mari în situația în care nu sunt utilizate	
N	1.6.6	(-) Elemente deductibile din Fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață, specifice României	
T	1.6.7	(-) Elemente neutilizate dar eligibile pentru includerea în fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.7	(-) DEDUCERI DIN TOTAL FONDURI PROPRII	0.00
T	1.7.1	Elemente deductibile din total fonduri proprii, specifice României	
N	1.7.2	Participații în entități de asigurare	
T	1.8	Elemente Memorandum:	
T	1.8.1	Excedent/Deficit de provizioane în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	0.00
T	1.8.1.1	Valoarea provizioanelor în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.8.1.1*	Din care : Provizioane pentru deprecieri identificate la nivelul grupurilor de active financiare	
T	1.8.1.1**	Din care: Provizioane specifice pentru deprecieri identificate la nivel individual	
T	1.8.1.1***	Din care: Ajustări de valoare și provizioane specifice României precum și alte ajustări și provizioane incluse în calculul excedentului (+)/deficitului (-) de provizioane în cazul aplicației	
T	1.8.1.2	(-) Valoarea pierderilor așteptate în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.8.2	Valoarea brută a împrumuturilor subordonate	
T	1.8.3	Capitalul inițial minim solicitat	422,712.50
T	2	CERINȚE DE CAPITAL	868,858.64
I	2a	Din care: Firme de investiții prevăzute la art.11 (2) și art. 13	
I	2b	Din care: Firme de investiții prevăzute la art. 11 (3) și art. 14	
T	2.1	TOTAL CERINȚE DE CAPITAL PENTRU RISCUL DE CREDIT, RISCUL DE CREDIT AL CONTRAPARTIDEI, RISCUL DE DIMINUARE A VALORII CREANȚEI ȘI PENTRU TRANZACȚII INCOMPLETE	0.00
T	2.1.1	Abordarea standard	0.00

T	2.1.1.1a	Clasele de expuneri potrivit abordării standard cu excepția pozițiilor din securitizare	0.00
T	2.1.1.1a.01	Administrații centrale sau bănci centrale	
T	2.1.1.1a.02	Administrații regionale sau autorități locale	
T	2.1.1.1a.03	Organisme administrative și entități fără scop lucrativ	
T	2.1.1.1a.04	Bănci multilaterale de dezvoltare	
T	2.1.1.1a.05	Organizații internaționale	
T	2.1.1.1a.06	Instituții	
T	2.1.1.1a.07	Societăți	
T	2.1.1.1a.08	De tip retail	
T	2.1.1.1a.09	Garantate cu proprietăți imobiliare	
T	2.1.1.1a.10	Elemente restante	
T	2.1.1.1a.11	Elemente ce aparțin categoriilor reglementate ca având risc ridicat	
T	2.1.1.1a.12	Obligațiuni garantate	
T	2.1.1.1a.13	Creanțe pe termen scurt față de instituții și societăți	
T	2.1.1.1a.14	Creanțe sub forma titlurilor de participare deținute în organismele de plasament colectiv	
T	2.1.1.1a.15	Alte elemente	
T	2.1.1.1b	Clasele de expuneri potrivit abordării bazate pe modele interne de rating cu excepția pozițiilor din securitizare	0.00
T	2.1.1.1b.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.1.1b.02	Instituții	
T	2.1.1.1b.03	Societăți	
T	2.1.1.1b.04	De tip retail	
T	2.1.1.1b.05	Creanțe provenind din titluri de capital	
T	2.1.1.1b.06	Active, altele decât cele care reprezintă creanțe de natura creditelor	
T	2.1.1.2	Poziții din securitizare potrivit abordării standard	
T	2.1.2	Abordarea bazată pe modele interne de rating	0.00
T	2.1.2.1	Abordări bazate pe modele interne de rating atunci când nu sunt utilizate estimările proprii ale pierderii în caz de nerambursare și nici ale factorilor de conversie	
T	2.1.2.1.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.2.1.02	Instituții	
T	2.1.2.1.03	Societăți	
T	2.1.2.2	Abordări bazate pe modele interne de rating atunci când sunt utilizate estimările proprii ale pierderii în caz de nerambursare și/sau ale factorilor de conversie	
T	2.1.2.2.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.2.2.02	Instituții	
T	2.1.2.2.03	Societăți	
T	2.1.2.2.04	De tip retail	
T	2.1.2.3	Expuneri din titluri de capital potrivit abordării bazate pe modele interne de rating	
T	2.1.2.4	Poziții din securitizare potrivit abordării bazate pe modele interne de rating	
T	2.1.2.5	Active, altele decât cele care reprezintă creanțe de natura creditelor	
T	2.2	RISC DE DECONTARE/LIVRARE	
T	2.3	CERINȚE TOTALE DE CAPITAL PENTRU RISCUL DE POZIȚIE, RISCUL VALUTAR ȘI RISCUL DE MAREĂ	441,785.62
T	2.3.1	Riscurile de poziție, valutar și de marfă potrivit abordării standard	441,785.62
T	2.3.1.1	Riscul de poziție aferent titlurilor de creanță tranzacționate	
T	2.3.1.2	Riscul de poziție aferent titlurilor de capital	370,021.11
T	2.3.1.3	Riscul valutar	71,764.51
T	2.3.1.4	Riscul de marfă	
T	2.3.2	Riscurile de poziție, valutar și de marfă potrivit modelelor interne	
T	2.4	TOTAL CERINȚE DE CAPITAL PENTRU RISCURILE OPERAȚIONALE	274,972.77
T	2.4.1	Abordarea de bază	274,972.77
T	2.4.2	Abordarea standard/Abordarea standard alternativă	
T	2.4.3	Abordarea avansată de evaluare	
I	2.5	CERINȚE DE CAPITAL AFERENTE CHELTUIELILOR GENERALE FIXE	152,100.25
T	2.6	ALTE CERINȚE DE CAPITAL ȘI CERINȚE DE CAPITAL TRANZITORII	0.00
T	2.6.1	Cerințe complementare pragului general stabilit pentru cerințele de capital	
N	2.6.2	Cerințe complementare pragului general stabilit pentru cerințele de capital, în cazul firmelor de investiții prevăzute la art. 46 din Directiva 2006/49/CE	
T	2.6.3	Alte cerințe de fonduri proprii	
T	3	ELEMENTE MEMORANDUM:	
T	3.1	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii înaintea aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	1,620,344.52
T	3.1.a	Indicatorul de solvabilitate înaintea aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	0.23
T	3.2	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii	1,620,344.52
T	3.2.a	Indicatorul de solvabilitate (%)	0.23
N			
N			
N			
N			

Intocmit
 AVRAM IOAN MALERIA (telefon 40.84.200)
 (numele, prenumele și telefonul)

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
 Tomescu Daniel
 (numele, prenumele și funcția)

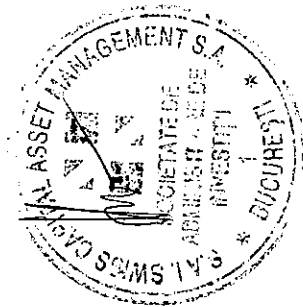


TABEL 4 RISC GENERAL SI SPECIFIC PE TITLURI DE CAPITAL

PORTOFOLIUL DE TITLURI	RISC GENERAL		RISC SPECIFIC	
	long	short	long	short
PORTOFOLIUL DE TITLURI	0.00	0.00	0.00	0.00
long	3083509.29	3083509.29		
ELEMENTE EXTRABILANTIERE	0.00			
long				
POZITIA NETA TOTALA	3083509.29			
POZITIA BRUTA TOTALA	0.00			
COEFICIENTI	0.00			
CERINTA DE CAPITAL	0.04			
pentru riscul general	246600.74			
pentru riscul specific	123340.37			
TOTAL				
CERINTA DE CAPITAL SUPLEMENTARA PENTRU INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE PE INDICI				0.00
CERINTA DE CAPITAL TOTALA		0		370921.11

denumire	Cantitate		Valoare		Valoarea unitară simbol		Cantitate
	short	long	short	long	short	long	
AVZU		2,376,500		61,789.00		AVZU	0,0260
GRU		5,887		1,824.97		GRU	0,3100
IMP		487,500		97,020.27		IMP	0,1950
MOIB		453,146		96,721.80		MOIB	0,2111
SIF 4		5,716,500		2,814,599.40		SIF 4	0,4924
BIO		59,500		11,659.75		SIF 5	0,1975

denumire	Poziția brută (cantitate)		Poziția brută (valoare)		Poziția netă	
	short	long	short	long	short	long
AVZU		2,376,500		61,789.00		61,789.00
GRU		5,887		1,824.97		1,824.97
IMP		487,500		97,020.27		97,020.27
MOIB		453,146		96,721.80		96,721.80
SIF 4		5,716,500		2,814,599.40		2,814,599.40
BIO		59,500		11,659.75		11,659.75
Poziția totală netă			0.00	3,083,509.29	0.00	3,083,509.29
Poziția totală brută						



Denumire SAI SWIS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA

Formular 10: MKR SA FX
RISC DE PIATĂ: ABORDĂRI STANDARD PENTRU RISCUL VALUTAR

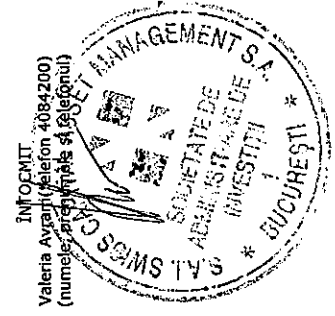
#RLAC10MKRSAFX01

- LEI -

POZIȚII TOTALE ÎN VALUTE, ALTELE DECAT MONEDA DE RAPORTARE	TOATE POZIȚIILE		POZIȚII NETE				POZIȚII SUPUSE CERINTELOR DE CAPITAL (Inclusiv redistribuirea pozițiilor nepuse în corespondență pe valutele care sunt supuse tratamentului special pentru pozițiile puse în corespondență)				CERINTE DE CAPITAL	
	LUNGI		LUNGI		SCURTE		LUNGI		SCURTE			PUSE ÎN CORESPONDENȚĂ
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)		
1 Valute în a 2-a etapă a UEM	897,056.34	0.00	0.00	897,056.34	0.00	0.00	897,056.34	0.00	0.00	0.00	0.00	71,764.51
2 Valute supuse acordurilor interguvernamentale												0.00
3 Valute străine corelate												0.00
4 Toate celelalte valute (inclusiv OPC-uri tratate ca valute diferite)	897,056.34	0.00	0.00	897,056.34	0.00	0.00	897,056.34	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
5 Aur												0.00
6 Riscuri aferente opțiunilor, altele decât riscul delta												0.00
7 Total	897,056.34			897,056.34			897,056.34					71,764.51

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
Tomescu Bogdan
(numele, prenumele și funcția)

CONDUCĂTORUL SSIF
Valis Ionela, director general adjunct
(numele, prenumele și funcția)

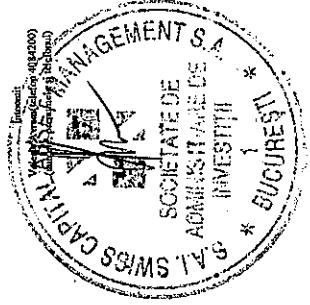


ACTIVITĂȚI	ELEMENTE MEMORANDUM AMA DE RAPORTAT DACA ESTE CAZUL											
	INDICATORUL RELEVANT			CERINȚE DE CAPITAL			CERINȚE DE CAPITAL ÎN CARE RĂSPUNDE UNU/MECANIISM DE ALOCARE			CERINȚE DE CAPITAL ÎN CARE RĂSPUNDE MECANISMUL DE ALOCARE		
	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT
1. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABORDĂRII DE BAZĂ (10)	2013.238.00	2.089.569.00	1.396.024.40			27.872.77						
2. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABORDĂRII DE BAZĂ ÎN STANDARUL ALTERNATIV (ASA)												
OBIECTUL SGA												
FINANȚIERAREA ACTIVITĂȚII (FS)												
FINANȚIERAREA ÎN BANCĂ (FB)												
PROCESUL DE RETAL (PR)												
ACTIVITATE BANCARĂ COMERCIALĂ (ABO)												
ACTIVITATE BANCARĂ DE RETAL (ABR)												
PLĂȚI ȘI DECONTĂRI (PD)												
SERVICIUL DE AGENT (AG)												
ADMINISTRAREA ACTIVELOR (AA)												
OBIECTUL ASA												
ACTIVITATE BANCARĂ COMERCIALĂ (ABO)												
ACTIVITATE BANCARĂ DE RETAL (ABR)												
3. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABORDĂRII AVANȘATE DE EVALUARE AMA (4)												

(4) Informații ce privesc la indicatorul relevant pentru activitățile ce fac obiectul tabelului AMA vor fi furnizate în cazul utilizării combinata de metodele diferite în conformitate cu art. 30-31 din Regulamentul nr. 2429/2006.

CONDUCĂTORUL SSIIF
Ioana Vălcuț director general adjoint
(nume, prenume și funcție)

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
Ioana Vălcuț
(nume, prenume și funcție)



Formular 9: MKR SA EQU
RISC DE PIATA: ABORDAREA STANDARD PENTRU RISCUL DE POZITIE AFERENT TITLURILOR DE CAPITAL

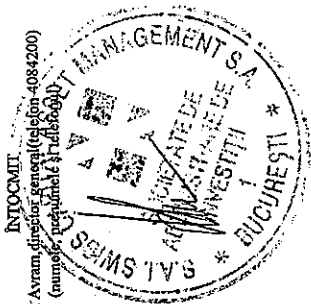
- LEI -

TOATE POZIȚIILE	LUNGI		SCURTE		POZIȚII NETE	LUNGI (4)	SCURTE (5)	POZIȚII NETE SUPUSE CERINȚELOR DE RISC (6)	CERINȚA DE CAPITAL (7)
	(1)	(2)	(3)	(7)					
	3,083,509.29	0.00	0.00	0.00					
3,083,509.29	0.00	0.00	0.00	3,083,509.29	0.00	0.00	3,083,509.29	123,340.37	
3,083,509.29	0.00	0.00	0.00	3,083,509.29	0.00	0.00	3,083,509.29	123,340.37	

Risc general
Risc specific
Abordare specială pentru riscul de poziție aferent OPC-urilor
Abordare pe bază de marjă pentru futures și opțiuni tranzacționate pe bursă
Abordare pe bază de marjă pentru futures și opțiuni tranzacționate pe OTC
Riscuri aferente opțiunilor, altele decât riscul de delta

CONDUCĂTORUL SSIF
Valeriu Ionel, director general adjuncț
(numele, prenumele și funcția)

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
Tomescu Daniel
(numele, prenumele și funcția)



#RLAC17RS01	Expuneri mari	RON	
Fonduri proprii	10%	20%	800%
2,489,203.16	248,920	497,841	622,301
			19,913,625

#RLAC17RS02	Expunerea mare înregistrată față de un client sau un grup de clienți	RON	
DENUMIRE/CLIENT	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
GRUP DE CLIENTI			
Total			
		% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA (%)

#RLAC17RS03 Expunere mare înregistrată față de un client sau un grup de clienți aflați în relații speciale (societatea-mamă, filiala instituției de credit și/sau una sau mai multe filiale ale acelei societăți-mamă)

#RLAC17RS03	Expunere mare înregistrată față de un client sau un grup de clienți aflați în relații speciale (societatea-mamă, filiala instituției de credit și/sau una sau mai multe filiale ale acelei societăți-mamă)	RON	
DENUMIRE/CLIENT	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
GRUP DE CLIENTI			
Total			
		% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA (%)

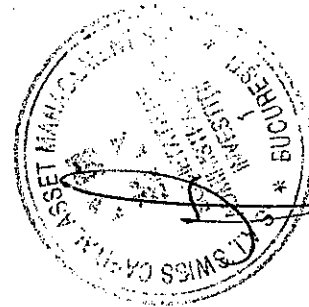
#RLAC17RS04	Expunere agregate	RON	
DENUMIRE/CLIENT	EXPUNERE AGREGATA	% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA (%)
GRUP DE CLIENTI	(TOTAL EXPUNERI MARI)		

#RLAC17RS05	Participații calificate	RON	
Fonduri proprii	15%	60%	1493522
2,489,203.16	373380		

#RLAC17RS06	Participații calificate	RON	
DENUMIRE ENTITATE	VALOAREA PARTICIPAȚIEI	% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA (%)
Total			
		DREPTURILE DE VOT ALE ENTITĂȚII	

#RLAC17RS07	Participații calificate	RON	
Fonduri proprii	25%		
2,489,203.16	622301		

#RLAC17RS08	Cheltuieli fixe	RON	
Cod cont.	Denumire Cont	VALOAREA	
clasa 61		229,377	
clasa 62		13,192	
clasa 63		36,093	
clasa 64		317,625	
clasa 65		12,114	
Total		608,401	



[Handwritten signature]

